

长城财富保险资产管理股份有限公司股票投资管理 能力建设及自评估情况（年度披露-20220126）

一、风险责任人

风险责任人：	风险责任人信息披露公告		
行政责任人：	刘文鹏	职务：	总经理
行政责任人类别：	授权总经理	是否履行完备的授权程序：	是
行政责任人性别	男	行政责任人出生年月	1972-03
行政责任人学历	博士研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	总经理室	行政责任人入司时间	2019-03-19
行政责任人专业资质	注册会计师	行政责任人专业技术职务	高级会计师
专业责任人：	王雪平	职务：	副总经理
专业责任人类别：	高级管理人员	是否履行完备的授权程序：	
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1974-07
专业责任人学历	博士研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2015-03-18	专业责任人所在部门	总经理室
专业责任人专业资质	具备相关投资领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	无

二、组织架构

整体评估情况：			
<p>公司按《保险机构股票投资管理标准》中的相关要求设置了股票投资组织架构，并设有独立的股票投资部门，组织架构包含股票投资部、投资研究部、集中交易部、运营保障部、风险合规部、信息技术部、人力资源部等；岗位设置明确，有股票投资、宏观策略研究、行业研究、股票交易、投资清算、估值核算、风险控制、系统支持、绩效评估等与股票投资流程上相关的岗位，并有明确的岗位职责，在研究、投资、交易岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离。公司建立了完善的防火墙机制，且拥有足够的股票投资场所，确保集中交易办公区域完全隔离。公司组织架构符合《保险机构股票投资管理标准》的要求。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	人力资源部		
发文时间	2020-12-22	文件名称（含文号）	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置：	薪酬福利兼员工关系岗，部门副总经理，部门总经理		
2			
部门名称	信息技术部		
发文时间	2020-12-22	文件名称（含文号）	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置：	系统维护岗，部门负责人		
3			
部门名称	投资研究部		
发文时间	2020-12-22	文件名称（含文号）	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置：	宏观策略研究岗，投资经理，行业研究岗，部门负责人		
4			

部门名称	股票投资部		
发文时间	2020-12-22	文件名称 (含文号)	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置:	总经理,投资经理,投资经理助理		
5			
部门名称	财务部		
发文时间	2020-12-22	文件名称 (含文号)	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置:	估值及会计核算岗		
6			
部门名称	运营保障部		
发文时间	2020-12-22	文件名称 (含文号)	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置:	清算岗,部门负责人		
7			
部门名称	集中交易部		
发文时间	2021-07-26	文件名称 (含文号)	长资人力【2021】7号关于进一步明确金融市场投资中心、集中交易部部门职责及岗位设置的通知
岗位设置:	权益交易岗,负责人		
8			
部门名称	风险合规部		
发文时间	2020-12-22	文件名称 (含文号)	长资人力【2020】8号关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知
岗位设置:	部门负责人,风险管理岗		
投资经理:	已根据账户/组合性质、管理资金规模等配备了独立的股票投资经理		
防火墙机制:	公司建立了相对集中、分级管理、权责统一的投资决策和授权制度,实行前台交易、资金管理和清算核算人员的严格分离,与股票投资业务相关的各部门均有独立的办公区域,同时投资、研究、交易等部门分别由不同的公司高管分管。各部门的股票投资相关人员之间,均建立了防火墙机制,包括但不限于:1.股票投资经理与基金投资经理之间;2.投资经理与交易人员之间;3.投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间;4.清算人员与核算人员之间。公司防火墙机制建设情况符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。		
评估结果:	符合规定		
投资场所:	公司租赁了完整的办公场所,保证各部门有独立的办公区域。公司建立全面的集中交易管理体系,包括但不限于设立集中交易室、实行门禁管理等,确保集中交易办公区域完全隔离。		
评估结果:	符合规定		

三、专业队伍

整体评估情况:					
我司受托管理的股票投资规模在10亿元以上,目前股票负责人具有16年以上的投资管理经验,股票投资团队共有专职人员14人,其中投资经理5人、研究员5人(主要研究员2人)、交易员2人、风控人员1人、清算人员1人。其中股票投资经理均具有3年以上的投资管理经验,主要研究员均具有3年以上的行业研究经验。上述团队专职人员均符合《保险机构股票投资管理标准》中对于人员从业经历的要求,岗位职责明确,有良好的过往业绩表现,能够较好的完成委托人的投资收益任务。公司专业队伍符合《保险机构股票投资管理标准》的基本要求。					
专业队伍人员基本信息:					
序号	姓名	岗位	是否为能力标准要求的专职人员	相关经验类型	相关经验年限
1	王迪斯	薪酬福利兼员工关系岗	否	其他	8.50

2	高国庆	系统维护岗	否	金融证券投资从业经验	0.00
3	万知	投资经理	是	股票投资管理经验	6.57
4	药晓东	行业研究岗	是	行业研究经验	0.46
5	孟晓林	行业研究岗	是	行业研究经验	5.50
6	王政眸	行业研究岗	是	行业研究经验	1.98
7	张译从	行业研究岗	是	行业研究经验	5.41
8	江维	行业研究岗	是	行业研究经验	10.86
9	王雪平	总经理	否	股票投资管理经验	9.41
10	陈莹	投资经理	是	股票投资管理经验	7.34
11	王卫华	投资经理	是	股票投资管理经验	11.17
12	胡纪元	投资经理	是	股票投资管理经验	4.36
13	周融	投资经理助理	是	股票投资管理经验	6.84
14	王璋	估值及会计核算岗	否	金融证券投资从业经验	4.83
15	沈莹	清算岗	是	金融证券投资从业经验	6.79
16	崔佳妮	权益交易岗	是	金融证券投资从业经验	13.70
17	姜亚男	权益交易岗	是	金融证券投资从业经验	7.66
18	侯文杰	风险管理岗	是	行业研究经验	2.52

四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>公司建立了完善、有效的股票投资管理制度，包括股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度，相关制度已经董事会、经营管理层等公司有权机构批准，以公司正式文件形式下发执行。主要制度包括：《授权管理细则（2021版）》、《权益投资管理办法》、《股票投资研究管理细则》、《股票池管理细则》、《集中交易管理办法》、《资产管理重大突发风险事件应急管理办法》等。公司制度建设符合《保险机构股票投资管理能力和标准》的要求。</p>		
股票投资基本制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
文档管理	符合规定	文件名称：档案管理办法， 发文文号：长资办【2020】7号， 发文时间：2020-08-04；
会议制度	符合规定	文件名称：关于加强公司会议管理工作的通知， 发文文号：长资办【2020】6号， 发文时间：2020-06-30；
清算与核算	符合规定	文件名称：公司投资清算管理细则， 发文文号：长资运保【2021】2号， 发文时间：2021-11-01；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：重大突发事件总体应急预案， 发文文号：长资办【2019】11号， 发文时间：2019-12-31； 文件名称：保密制度， 发文文号：长资办【2019】7号， 发文时间：2019-12-31； 文件名称：资产管理重大突发风险事件应急管理办法， 发文文号：长资风险【2019】5号， 发文时间：2019-02-08；
业务流程	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司权益投资管理办法， 发文文号：长资权益【2019】4号， 发文时间：2019-12-31；
绩效考核	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司投资业务绩效考核实施细则， 发文文号：长资人力【2021】9号， 发文时间：2021-07-30；

信息系统管理	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司信息技术资产管理办法， 发文文号：长资信息【2020】1号， 发文时间：2020-07-21； 文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司信息安全管理办法， 发文文号：长资信息【2021】1号， 发文时间：2021-04-22；
操作规程	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司权益投资管理辦法， 发文文号：长资权益【2019】4号， 发文时间：2019-12-31；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知， 发文文号：长资人力【2020】8号， 发文时间：2020-12-22；
决策管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
投资决策体系	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司权益投资管理辦法， 发文文号：长资权益【2019】4号， 发文时间：2019-12-31；
授权管理	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司权益投资管理辦法， 发文文号：长资权益【2019】4号， 发文时间：2019-12-31； 文件名称：授权管理细则（2021版）， 发文文号：长资【2021】6号， 发文时间：2021-04-06； 文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司授权管理制度， 发文文号：长资【2021】9号， 发文时间：2021-10-14；
实施与控制	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司权益投资管理辦法， 发文文号：长资权益【2019】4号， 发文时间：2019-12-31；
研究管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司股票期货及衍生品投资交易单元管理细则， 发文文号：长资研究【2021】3号， 发文时间：2021-11-03；
研究管理办法	符合规定	文件名称：股票投资研究管理细则， 发文文号：长资权益【2019】7号， 发文时间：2019-12-31；
股票池管理办法	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司股票池管理细则， 发文文号：长资权益【2021】5号， 发文时间：2021-12-13；
交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
交易监控	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司集中交易管理办法， 发文文号：长资交易【2021】6号， 发文时间：2021-12-03；
集中交易	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司集中交易管理办法， 发文文号：长资交易【2021】6号， 发文时间：2021-12-03；
公平交易	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司集中交易管理办法， 发文文号：长资交易【2021】6号， 发文时间：2021-12-03；
交易权限管理	符合规定	文件名称：长城财富保险资产管理股份有限公司集中交易管理办法， 发文文号：长资交易【2021】6号， 发文时间：2021-12-03；

五. 系统建设

整体评估情况:			
公司采购了相关信息系统以支持股票二级市场投资相关业务的正常运作,包括研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统,涵盖宏观研究、股票行业研究、个股研究、股票池基金池管理、集中交易、清算和估值等主要功能,符合《保险机构股票投资能力标准》中的相关要求。			
交易管理系统:			
系统名称	恒生一体化系统		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	恒生一体化系统具备授权管理、合规控制和交易功能等,具有多模式接入和下单,多市场交易通道,专业交易执行(算法交易和策略交易等)、风险和信用控制、以及其他相关账户合规、清算对账,资金结算等功能,符合监管相关要求。		
信息资讯系统:			
系统名称	大智慧金融终端		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	大智慧金融终端向投资者提供及时、专业的金融数据和数据分析;提供专业的财务数据;提供个性化编写股票池;并获得多家券商支持,符合监管相关要求。		
系统名称	朝阳永续金融终端		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	朝阳永续是国内领先的金融数据提供商,有海量的上市公司盈利预测数据库,证券行业量化投资研究基础数据库,同时拥有专利的“一致预期”系统;获得多家券商支持,符合监管相关要求。		
系统名称	Wind金融终端		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	Wind金融终端包括股票、债券、期货、外汇、基金、指数、权证、宏观行业等多项品种,7×24×365不间断的为金融机构、政府组织、企业、媒体提供准确、及时、完整的金融数据资讯并获得多家券商支持,符合监管相关要求。		
研究分析系统:			
系统名称	iFind投研知识平台		
上线时间	2020-09-01	评估结果	符合规定
主要功能	iFind投研知识平台包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告系统等功能,可以有效的评估内、外部研究成果及绩效归因,符合监管相关要求。		
资产估值和核算系统:			
系统名称	恒生一体化系统		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	恒生一体化系统具备安全、高效的清算交割、财务核算系统,能够每日进行清算和估值,实现报表自动生成等,符合监管相关要求。		

六. 风险控制

整体评估情况:			
公司制定《全面风险管理制度》、《权益类证券投资风险控制办法》、《权益类证券投资风险限额管理指引》《上市权益类资产风险管理细则》等股票投资风管理制度。建立了事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系,建立明确的决策与授权机制、严谨高效的业务操作流程、完善的风险管理制度、风险处置预案和责任追究机制,明确投资决策、交易执行、投后管理、信息披露等环节的内控要求,实行独立于投资管理的报告制度。公司股票投资风管理制度建设情况和风险控制体系符合《保险机构股票投资管理力标准》。			
压力测试系统:			
系统名称	恒生一体化系统		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	公司对权益类资产风险价值定期进行压力测试(包括但不限于股票仓位、行业集中度、个股集中度等方面),同时评估投资组合产生的影响通过VAR分析和综合情景压力测试评估投资组合潜在损失情况,并根据公司应急管理制度制定相应的应急预案。系统功能符合《保险机构股票投资管理力标准》的相关要求。		

风险管理系统：			
系统名称	恒生一体化系统		
上线时间	2015-03-18	评估结果	符合规定
主要功能	在恒生交易系统内对各项投资风险控制阈值进行设定，实现了风险预警和风险管理自动化和系统化，对投资过程进行监控、授权控制及交易执行进行监督管理；绩效评估系统采用绩效评估与风险管理系统3.0，系统功能符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。		

七、自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理监管有关事项的通知》及相关监管规定，我对保险资管公司股票投资管理能力建设进行了调研论证和自我评估，经过充分论证和评估，我达到了该项能力的基本要求，现按规定披露相关信息。

我承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。